

Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi
RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) PIP-ITALIANA LINEA FUTURO
 SEZIONE PATRIMONIALE AL 31-12-2020

Allegato 1

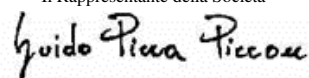
ATTIVITA'	Situazione al 31-12-2020		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale attività	Valore complessivo	% sul totale attività
A. STRUMENTI FINANZIARI NEGOZIATI	24.902.447,11	95,16	20.361.674,58	92,96
A1. Titoli di debito	4.501.427,08	17,20	3.681.373,57	16,81
A1.1. Titoli di Stato	4.501.427,08	17,20	3.681.373,57	16,81
A1.2. Obbligazioni ed altri titoli assimilabili				
A1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
A2. Titoli azionari	20.401.020,03	77,96	16.680.301,01	76,15
A3. Parti di O.I.C.R.				
B. STRUMENTI FINANZIARI NON NEGOZIATI				
B1. Titoli di debito				
B1.1. Titoli di Stato				
B1.2. Obbligazioni e altri titoli assimilabili				
B1.3. Titoli strutturati ed altri strumenti ibridi				
B2. Titoli azionari				
B3. Parti di O.I.C.R.				
C. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
C1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
C1.1. Warrant				
C1.2. Diritti su partecipazioni in portafoglio				
C2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
D. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE ATTIVITA' MONETARIE				
E. DEPOSITI BANCARI	1.234.184,62	4,72	1.510.886,62	6,90
F. Liquidità da impegnare per operazioni da regolare				
G. MUTUI E PRESTITI GARANTITI				
H. ALTRE ATTIVITA'	31.717,72	0,12	32.090,13	0,15
H1. Ratei attivi	31.717,72	0,12	32.090,13	0,15
H2. Altri attivi (da specificare)				
H2.1. Crediti d'imposta				
H2.2. Crediti per ritenute				
H2.3. Commissioni Retrocedute				
H2.4. Crediti tax reclaim				
TOTALE ATTIVITA'	26.168.349,45	100,00	21.904.651,33	100,00

PASSIVITA' E NETTO	Situazione al 31-12-2020		Situazione a fine esercizio precedente	
	Valore complessivo	% sul totale	Valore	% sul totale
I. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI				
I1. Negoziati (da specificare ulteriormente)				
I2. Non negoziati (da specificare ulteriormente)				
I2.1. Interest rate swap				
L. PRONTI CONTRO TERMINE O ALTRE PASSIVITA' MONETARIE				
M. ALTRE PASSIVITA'	-132.656,36	100,00	-114.137,52	100,00
M1. Ratei passivi				
M2. Spese pubblicazione quota				
M3. Spese revisione rendiconto				
M4. Commissione di gestione	-132.656,36	100,00	-114.137,52	100,00
M5. Passività diverse				
TOTALE PASSIVITA'	-132.656,36	100,00	-114.137,52	100,00
VALORE COMPLESSIVO NETTO DEL FONDO		26.035.693,09		21.790.513,81
Numero delle quote in circolazione		2.548.517,350		2.058.448,861
Valore unitario delle quote		10,216		10,585

Movimenti delle quote dell'esercizio	I trimestre	II trimestre	III trimestre	IV trimestre
Quote emesse	144.890,930	196.490,170	131.144,727	232.966,695
Quote rimborsate	75.581,587	48.004,397	32.659,370	59.178,679

Milano, 29/01/2021

Il Rappresentante della Società



Schema di rendiconto dei fondi interni assicurativi

Allegato 2

**RENDICONTO DEL FONDO INTERNO (comparto) PIP-ITALIANA LINEA FUTURO
 SEZIONE REDDITUALE AL 31-12-2020**

	Rendiconto al 31-12-2020	Rendiconto esercizio precedente
A. STRUMENTI FINANZIARI		
A1. PROVENTI DA INVESTIMENTI	405.795,69	489.552,30
A1.1. Interessi e altri proventi su titoli di debito	65.508,99	64.335,50
A1.2. Dividendi e altri proventi su titoli azionari	340.286,70	425.216,80
A1.3. Proventi su parti di O.I.C.R.		
A2. UTILE/PERDITA DA REALIZZI	-1.019.141,44	609.028,90
A2.1. Titoli di debito	-4.169,39	96.730,22
A2.2. Titoli azionari	-1.014.972,05	512.298,68
A2.3. Parti di O.I.C.R.		
A3. PLUSVALENZE/MINUSVALENZE	708.399,92	2.777.246,33
A3.1. Titoli di debito	109.606,59	6.074,89
A3.2. Titoli di capitale	598.793,33	2.771.171,44
A3.3. Parti di O.I.C.R.		
Risultato gestione strumenti finanziari	95.054,17	3.875.827,53
B. STRUMENTI FINANZIARI DERIVATI		
B1. RISULTATI REALIZZATI	-3.416,32	
B1.1. Su strumenti negoziati	-3.416,32	
B1.2. Su strumenti non negoziati		
B2. RISULTATI NON REALIZZATI		
B2.1. Su strumenti negoziati		
B2.2. Su strumenti non negoziati		
Risultato gestione strumenti finanziari derivati	-3.416,32	
C. INTERESSI ATTIVI		
C1. SU DEPOSITI BANCARI		
C2. SU MUTUI E PRESTITI GARANTITI		
D. RISULTATO DELLA GESTIONE CAMBI		
D1. RISULTATI REALIZZATI		
D2. RISULTATI NON REALIZZATI		
E. PROVENTI SU CREDITI		
F. ALTRI PROVENTI		
F1. PROVENTI SULLE OPERAZIONI DI PRONTI CONTRO TERMINE ATTIVI		
F2. PROVENTI DIVERSI		
Risultato lordo della gestione di portafoglio	91.637,85	3.875.827,53
G. ONERI FINANZIARI E D'INVESTIMENTO (specificare)	-41.420,99	-31.190,31
G1. Bolli, spese e commissioni	-41.420,99	-31.190,31
Risultato netto della gestione di portafoglio	50.216,86	3.844.637,22
H. ONERI DI GESTIONE	-484.369,59	-433.190,53
H1. Commissione di gestione	-480.761,50	-429.353,99
H2. Spese pubblicazione quota		
H3. Spese di gestione, amministrazione e custodia	-8,00	-8,00
H4. Altri oneri di gestione	-3.600,09	-3.828,54
I. ALTRI RICAVI E ONERI	10.703,99	17.448,78
I1. Altri ricavi	10.703,99	17.448,78
I2. Altri costi		
Utile/perdita della gestione del Fondo	-423.448,74	3.428.895,47

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione	-3,49	Volatilità della gestione	22,79
Rendimento del benchmark	-1,02	Volatilità del benchmark **	
Differenza	-2,47	Volatilità dichiarata ***	15,00 / 20,00

* Per le imprese che hanno adottato un benchmark

** indicate soltanto in caso di gestione passiva

*** indicate soltanto in caso di gestione attiva

SEZIONE DI CONFRONTO *

Rendimento della gestione		Volatilità della gestione	
		Volatilità dichiarata	

* Per le imprese che non hanno adottato un benchmark

Milano, 29/01/2021

Il Rappresentante della Società

Guido Piva Piccone